

Fecha de Publicación: 17 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 13 de Marzo de 2008 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$795,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	124,8	296,4	93,4	76,8	155,0	-	373,2
15-35	162,0	177,0	160,0	138,0	3,0	10,0	325,1
36-60	4,8	20,0	20,0	4,8	-	-	24,9
61-90	0,3	0,0	0,0	0,3	-	-	0,3
91-180	34,3	15,6	11,6	30,3	-	-	45,9
>180	11,3	15,0	15,0	11,3	-	-	26,3
Total	337,5	524,1	300,1	261,5	158,0	10,0	795,6

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales)

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,6 %	16,9 %	8,9 %	10,5 %
15-35	6,3 %	10,4 %	8,0 %	9,1 %
36-60	-	7,4 %	9,4 %	7,8 %
61-90	-	12,2 %	7,4 %	7,8 %
91-180	4,1 %	8,3 %	7,0 %	7,1 %
>180	-	8,6 %	7,3 %	8,0 %
Total	2,0 %	12,0 %	8,1 %	9,4 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	10 al 14 de Marzo				17 al 21 de Marzo				24 al 28 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	37	1581	1751	9	24	1457	2155	16	50	1359	1251
Otros***	37	36	1186	1136	24	9	1226	1017	50	16	776	1063
Intragrupo	0	0	395	274	0	0	489	0	0	0	179	1
Total	72	72	3161	3161	33	33	3171	3171	67	67	2314	2314

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Otros agentes sin intragrupo

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo